

## عنوان مقاله:

رابطه بین نااطمینانی ریسک و سرمایه گذاری رقابتی در بازار

## محل انتشار:

دومین همایش ملی بهبود و بازسازی سازمان و کسب و کار (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

## نویسنده:

علی یویان نژاد - دانش آموخته dba، دانشکده مدیریت، دانشگاه تهران، تهران، ایران

## خلاصه مقاله:

هدف تحقیق حاضر بررسی رابطه بین نااطمینانی ریسک و سرمایه گذاری رقابتی در بازار بوده است. یکی از ویژگی های بازار بورس، نوسانات زیاد قیمتتها می باشد که سبب ایجاد ریسک قیمت می گردد از آنجایی که در اقتصاد ایران بورس و فعالیتهای بورس به عنوان یک ابزار کارآمد در ایران شناخته نشده است و نوسانات قیمت به دلیل شرایط اقتصادی بالا می باشد و ریسک قیمت اثرات منفی بر اقتصاد کشور وارد می کند. لذا مدیریت و پوشش این ریسک به وسیله راهکارهای مناسب ضروری به نظر می رسد. یکی از راهکارهای مقابله با ریسک استفاده از ابزار مشتقه مالی و ورود به معاملات کاغذی می باشد که در این تحقیق به آن پرداخته شده است. در این مطالعه به منظور بررسی نرخ های پوششی و انتخاب بهترین آنها، از سرمایه گذاری رقابتی کوتاه مدت، میان مدت و بلند مدت بورس اوراق بهادار تهران مربوط به سالهای ۱۳۹۹-۱۴۰۰ استفاده شده است و داده ها به صورت روزانه می باشد. نرخهای پوششی به وسیله برآورد مدلهای حداقل مربعات معمولی (OLS)، ارزش در معرض ریسک (VAR) و مدل تصحیح خطای برداری (VECM) محاسبه شدند.

## کلمات کلیدی:

سرمایه گذاری رقابتی، نااطمینانی ریسک، مدیریت ریسک، ابزار مشتقه، قیمت نقدی، کارائی پوشش ریسک

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1625167>

